

芝加哥期货交易所处罚通告

文件编号: **CBOT 15-0230-BC**

非会员: **Wen-Hsiung Cheng**

CBOT规则

违反: **规则432。 (“一般违规行为”) (部分)**

以下行为属违规:

L. 1. 未能在经适当召集的听证会、安排的工作人员约谈或与任何调查有关出现在交易所、交易所工作人员或任何调查或听证委员会面前。

规则575。禁止破坏性做法 (部分) :

所有订单必须出于执行真实交易之目的而输入。此外，所有不可执行的消息必须出于合理目的而善意地输入。

任何人均不得在输入订单时意图在执行前撤销或修改订单以避免执行而输入或促成输入订单。

调查结果: 2017年6月28日，芝加哥期货交易所（“CBOT”）调查委员会（“PCC”）的审查小组指控非会员Wen-Hsiung Cheng（“Cheng”）违反了CBOT规则432.L和575.A.，依据是在2014年10月1日至2015年5月20日，Cheng在开市前议价时段在Globex燕麦和糙米（“大米”）期货市场输入了并非为了执行真实交易而善意作出的订单，造成公开显示的指示性开盘价格（“IOP”）出现波动，并且Cheng未能参加有关该案的调查而安排的市场监管约谈。

2017年10月4日，CBOT商业行为委员会（“BCC”）听证小组作出了认为Cheng未能回答对他提出之指控的裁定。由于未能回答指控，听证小组进一步裁定Cheng被视为已承认提出的指控并放弃要求对指控理据进行听证的权利。

依照CBOT规则407.C.，2017年10月18日BCC审查小组（“审查小组”）举行了处罚听证会。审查小组认为Cheng实施了承认的指控行为。

处罚: 基于相关记录以及审查小组的调查结果和结论，审查小组责令支付50,000美元罚金，并在五年内禁止Cheng（1）获得任何芝商所交易所的会籍和特权；（2）直接或间接进入和使用任何芝商所交易大厅、任何芝商所交易所拥有或经营的电子交易或清算平台；及（3）加入、受雇于任何芝商所交易所的会员（规则400所定义）或会员的附属机构或与之有业务往来。

生效

日期: 2017年11月3日